

摩根士丹利华鑫深证300指数增强型证券投资基金

【2012】年度报告摘要

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费

8) 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金

[illegible]

7.1资产负债表					
截止至:香港上月利华鑫深证300指数增强型证券投资信托基金					
报告截止日期:2012年12月31日					
单位:人民币元					
资产	本期末 2012年12月31日	上年末 2011年12月31日			
货币资金	-	-	注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。		
银行存款	9,251,754.22	35,549,544.19	7.4.8.8报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的权证交易。		
结算备付金	386,216.99	13,709,968.48	7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易		
存出保证金	1,764,245.42	-	7.4.8.1股票交易		
交易性金融资产	136,432,229.66	175,851,649.86	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
其中:股票投资	136,432,229.66	175,851,649.86	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
债券投资	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
衍生金融资产	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
买入返售金融资产	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
应收证券清算款	3,031,768.83	170,048,689.92	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
应收利息	2,216.64	17,938.62	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
应收股利	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
应收申购款	49,154.18	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
递延所得税资产	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
其他资产	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
资产总计	150,917,585.94	395,177,791.07			
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年末 2011年12月31日			
负债:	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
短期借款	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
交易性金融负债	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
卖出回购金融资产款	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
应付赎回款	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
应付佣金	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
应付税费	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
应付利息	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
应付股利	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
其他负债	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年末 2011年12月31日			
实收资本	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
资本公积	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
盈余公积	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
未分配利润	-	-	基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金注册登记机构等之间的关联交易		
所有者权益合计	150,917,585.94	395,177,791.07			

应付证券清算款	-	-	-	注1：应付证券清算款为应付证券清算款，以中国证券登记结算有限责任公司和中国证券登记结算有限公司的名义开立的证券账户和基金账户的清算净额。
应付赎回款	729,531.89	-	-	2、应付赎回款为基金赎回款，以中国证券登记结算有限责任公司和中国证券登记结算有限公司的名义开立的证券账户和基金账户的清算净额。
应付管理人报酬	116,721.61	-	343,267.25	7.4.8.2关联方报酬
应付托管费	17,506.25	-	51,490.00	7.4.8.2.1基金管理费
应付销售服务费	-	-	-	单位：人民币
应付交易费用	211,055.34	-	252,597.32	项目
应交税费	-	-	-	本期
应付利息	-	-	-	2012年12月31日
应付利润	-	-	-	上年度可比期间
递延所得税负债	-	-	-	2011年11月15日(基金合同生效日)
其他负债	2,285,888.23	-	-	2011年12月31日
负债合计	3,360,705.22	-	667,681.46	当期发生的基金应支付的管理费
所有者权益：	-	-	-	其中：支付销售机构的客户维护费
实收资本	163,261,917.18	-	421,922,840.88	注：支付基金管理人摩根士丹利华鑫基金管理有限公司的管理人报酬按一日基金资产净值1.00%的年费率计提，
未分配利润	-15,705,036.46	-	-27,412,731.27	日累计至每月月底，按月支付，其计算公式为：
所有者权益合计	147,556,880.72	-	394,510,109.61	日管理人报酬=（日基金资产净值×1.00%）÷当年天数。
负债和所有者权益总计	457,917,585.94	-	395,197,791.07	7.4.8.2.2基金托管费
注1：报告期末于12月31日12月31日，基金资产净值904元，基金净值总额637,261,917.18份，报告截止于12月31日12月31日，基金资产净值904元，基金净值总额421,922,840.88份。	-	-	-	单位：人民币
注2：本报告表的实际编制期间为2011年11月15日 基金合同生效日至2011年12月31日止期间。	-	-	-	项目
	-	-	-	本期
	-	-	-	2012年1月1日
	-	-	-	2012年12月31日
	-	-	-	2011年11月15日(基金合同生效日)
	-	-	-	2011年12月31日
	-	-	-	当期发生的基金应支付的托管费
	-	-	-	注：支付基金管理人中国建设银行有限责任公司的托管费按一日基金资产净值的0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。
	-	-	-	日托管费=（日基金资产净值×0.15%）÷当年天数。
	-	-	-	7.4.8.2.3基金销售服务费
	-	-	-	注：支付基金销售服务费按基金资产净值的0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。
	-	-	-	日销售服务费=（日基金资产净值×0.5%）÷当年天数。

基金名称: 鹏华上证红利指数证券投资基金 报告期间: 2012年1月1日至2012年12月31日		单位: 人民币元	
项目	本期 2012年1月1日 至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	7.4.8.2 说明与关联方进行的所有重要交易。7.4.8.3 关联方交易: 关联方名称、关联方关系、关联方提供服务的性质、定价政策、交易类型、交易金额。7.4.8.4 关联方投资: 关联方名称、关联方关系、关联方提供服务的性质、定价政策、交易类型、交易金额。7.4.8.5 关联方担保: 关联方名称、关联方关系、关联方提供服务的性质、定价政策、交易类型、交易金额。7.4.8.6 关联方其他: 关联方名称、关联方关系、关联方提供服务的性质、定价政策、交易类型、交易金额。
一、收入	10,818,823.66	-26,433,965.23	7.4.8.7 关联方投资: 关联方名称、关联方关系、关联方提供服务的性质、定价政策、交易类型、交易金额。7.4.8.8 关联方担保: 关联方名称、关联方关系、关联方提供服务的性质、定价政策、交易类型、交易金额。7.4.8.9 关联方其他: 关联方名称、关联方关系、关联方提供服务的性质、定价政策、交易类型、交易金额。
1.利息收入	616,303.79	733,209.77	7.4.8.10 关联方其他: 关联方名称、关联方关系、关联方提供服务的性质、定价政策、交易类型、交易金额。

单位: 人民币元

[illegible][illegible][illegible][illegible][illegible]

上海利得基金资产管理有限公司(以下简称“利得基金”)为经中国证监会核准的基金管理公司,其基本情况如下: 1. 名称:上海利得基金资产管理有限公司 2. 住所:上海市浦东新区世纪大道1500号1002室 3. 办公地址:上海市浦东新区世纪大道1500号1002室 4. 法定代表人:曹建刚 5. 总经理:曹建刚 6. 成立日期:2014年12月26日 7. 注册资本:100,000,000.00元人民币 8. 股权结构:上海利得基金资产管理有限公司的股权结构如下: 9. 经营范围:基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务。	10. 基金管理人:上海利得基金资产管理有限公司 11. 基金托管人:中国建设银行股份有限公司 12. 基金名称:利得基金 13. 基金类型:货币市场基金 14. 基金规模:人民币100,000,000.00元 15. 基金费率:管理费0.30%,托管费0.10%,销售服务费0.30% 16. 基金风险:低风险 17. 基金投资:投资于货币市场工具 18. 基金收益:每日计提,按月支付 19. 基金赎回:赎回费0.10% 20. 基金分红:红利再投资
---	--

100%投资于股票和可转债的资产比例不低于基金资产净值的80%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-10%；保持现金和到期日在一年以内的国债、金融债及货币市场工具占基金资产净值的5%；股票资产中，投资于沪深300指数成份股资产的比例不低于基金股票资产净值的50%；本基金为主动管理型基金，追求长期超越业绩比较基准的投资回报，力争绝对收益，但个别交易日净赎回或净申购金额大于前一日基金资产净值的0.5%，年化跟踪误差大于或超过7.5%。本基金业绩比较基准为：中证300价格指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。 3. 基金13日份额报表如下 7.4.2 会计报告用的编制基础 本财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告〔2010〕35号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号——基金财务报表和信息披露XBRL模板第3号——基金财务报表和信息披露XBRL模板第3号——基金财务报表和信息披露XBRL模板第3号》编制。	其中：股票 136,432,229.66 90.40
--	---

[illegible]

生效)至2019年12月31日止期间。					9%
7.4.4.2可供出售资产	A	农林牧渔业	3,339,461.99	2.40	
7.4.4.3可供出售权益工具投资	B	制造业	5,562,440.90	3.00	
7.4.4.3金融资产和金融负债的分类	C	制造业	67,762,743.98	45.92	
(1)金融资产分类	D	食品、饮料	8,962,157.51	6.07	
金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资的金融资产。分类取决于本基金对金融资产的持有意图和有能力。本基金无金融资产分类为可供出售金融资产。	E	纺织服装、皮革鞋业	74,356.34	0.51	
本基金目前持有的金融资产投资，包括投资和衍生工具，主要为股权投资。分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。	F	木材、家具	-	-	

[illegible]

的公允价值变动或处置损益计入当期损益的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融项目的相关交易费用计入初始确认金额。	C	电力、热力、燃气及水的生产和供应业	2,456,459.06	1.66
2. 公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融项目采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。	D	建筑业	2,444,146.54	1.66
3. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;公允价值变动损益计入当期损益;在资产持有期间收到的利息或股利收入以及处置时产生的处置损益计入当期损益。	E	交通运输、仓储业	1,778,414.51	1.21
4. 金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认: 1) 收取该金融资产现金流量的合同权利已过期; 2) 该金融资产已转移,且企业没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬;但金融资产已转移,且企业保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但放弃了对该金融资产的控制。	F	信息技术业	3,065,317.40	2.08
	H	批发和零售贸易	4,343,686.42	2.94
	I	金融、保险业	4,493,626.26	2.96

[illegible][illegible][illegible]

		2,700,172,000	1,000
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表日的公允价值变动计入公允价值变动损益。在处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。	C99 其他衍生资产		
应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算。实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。	D 电力、煤气、水气的生产和供应业		
4.10 费用确认和计量	E 建筑业		
本公司的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。	F 交通运输、仓储业		
其他金融资产持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。	G 信息技术业		
4.11 金融负债的分类和计量	H 批发和零售贸易		
金融负债有持有至到期投资、公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、可供出售金融资产和贷款承诺。金融负债在初始确认时划分为以下三类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、持有至到期投资、可供出售金融资产和贷款承诺。			
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，包括交易性金融负债和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。交易性金融负债的公允价值变动计入公允价值变动损益。在处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。			
持有至到期投资：是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且企业有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。持有至到期投资按公允价值进行初始计量，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。			
可供出售金融资产：是指初始确认时即被指定为可供出售的非衍生金融资产，以及没有划分为持有至到期投资和贷款承诺的其他金融资产。可供出售金融资产按公允价值进行初始计量，公允价值变动计入资本公积（其他资本公积）。处置可供出售金融资产时，应将取得的价款与该金融资产账面价值之间的差额，计入投资损益。在可供出售金融资产发生减值时，按初始入账金额超过该资产公允价值减去未实现损失后的余额，确认为减值损失，计入当期损益。可供出售金融资产公允价值后续上升且客观上与确认原减值损失事项无关的，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。			
贷款承诺：是指本行向客户提供的、在未来一定期限内以约定条件提供贷款的承诺。贷款承诺按公允价值进行初始计量，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。			

1	金融、保险业	3,073,446.00	2.08
2	J 房地产业	—	—
3	K 社会服务业	960,700.00	0.65
4	L 传播与文化产业	1,428,300.00	0.97
5	M 综合类	—	—
6	合计	17,692,612.50	11.99

8.3.6 前次公开增发后公司基本每股收益较前次增发前两个年度的同期分别下降 1.06 个百分点和 1.06 个百分点。

条件的, 仍作为一个整体考虑。 本基金以公允价值计量的投资品种公允价值, 不需要进行公允价值披露。 7.4.13其他重要的会计政策和估计 根据本基金公允价值确定和中国证监会公允价值业务操作, 本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法: 对于证券交易所上市的本基金投资的, 有重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停)等特殊情况, 本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步加强非公开发行股票估值业务指导意见》, 根据停牌前最后一个交易日的收盘价, 并考虑停牌期间行业指数和同类个股涨跌幅度, 对停牌股票公允价值进行调整。 7.4.5会计政策和会计估计变更及差错更正的重要说明	8.3.1报告期内股票投资收益按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 <table> <tr> <th>序号</th><th>股票代码</th><th>股票名称</th><th>数量(股)</th><th>公允价值</th><th>占基金资产净值比例(%)</th></tr> <tr> <td>1</td><td>000002</td><td>万科A</td><td>527,884</td><td>5,342,186.08</td><td>3.62</td></tr> <tr> <td>2</td><td>000061</td><td>格力电器</td><td>149,267</td><td>3,806,308.50</td><td>2.58</td></tr> <tr> <td>3</td><td>000001</td><td>平安银行</td><td>191,184</td><td>3,062,768.28</td><td>2.08</td></tr> </table>	序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)	1	000002	万科A	527,884	5,342,186.08	3.62	2	000061	格力电器	149,267	3,806,308.50	2.58	3	000001	平安银行	191,184	3,062,768.28	2.08
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)																				
1	000002	万科A	527,884	5,342,186.08	3.62																				
2	000061	格力电器	149,267	3,806,308.50	2.58																				
3	000001	平安银行	191,184	3,062,768.28	2.08																				

7.4.5.3	基金本报告期末无发生会计估计变更。	4	0.0838	五粮液	147.60	2,482,743.81	1.68
7.4.5.2	会计估计变更的说明	5	0.0076	恒瑞医药	147.60	2,276,038.94	1.54
7.4.5.1	本基金本报告期无会计估计变更。	6	0.0038	恒瑞医药	82.244	2,081,595.64	1.41
7.4.5.3	会计差错更正说明	7	0.00024	招商地产	67.742	2,024,808.38	1.37
7.4.5.2	本基金本报告期无须说明的会计差错更正。	8	0.00157	中联重科	201.490	1,855,722.90	1.26
7.4.5.1	根据财政部、国家税务总局财税[2012]121号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2012]102号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及国家税务总局公告2015年第40号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》有关规定，自2015年1月1日起，上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知。	9	0.00100	TCL 集团	817.979	1,791,374.01	1.21
7.4.5.3	根据财政部、国家税务总局财税[2012]121号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2012]102号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及国家税务总局公告2015年第40号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》有关规定，自2015年1月1日起，上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知。	10	0.00092	蓝帆股份	66.787	1,789,894.60	1.21

注：投资收益了解本报告期末基金投资的所有股票简称，应阅读登载于基金管理人网站 <http://www.msmsun.com.cn/> 年度报告正文。

金额单位：人民币元				
序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000776	广发证券	9,649,104.04	2.45
2	000686	东北证券	8,728,826.67	2.21
3	600259	广晟有色	8,272,660.82	2.10
4	601992	金隅股份	7,637,603.73	1.94

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000776	广发证券	10,002,378.91	2.54
2	000686	东北证券	8,979,104.36	2.28
3	601988	中国银行	7,171,000.00	1.82
4	002350	广信股份	7,076,303.43	1.79

8.4.3.9: 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额		单位: 人民币元
买入股票的成本(成交)总额		421,013,759.91
卖出股票的收入(成交)总额		468,577,129.47

注: 1. “买入股票成本”, “卖出股票收入”均按买入成交金额、成交单价乘以成交数量填列, 不考虑相关交易费用。
2. 1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
3. 1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,764,245.42
2	应收证券清算款	3,031,768.83
3	应收股利	—

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	5,342,186.08	3.62	重大事项停牌

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

4,602	35,476.30	7,234,601.32	4.43%	156,027,315.86	95.57%
-------	-----------	--------------	-------	----------------	--------

9.2 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总额(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	455,466.34	0.279%

注：1. 本公司高级管理人员、基金投资和研究人员持有本基金份额总量的数量区间为0至10万份（含）。
2. 本基金的基金经理未持有本基金。

开 发 者	本报告期末基金份额总额	163,261,917.18
三 发	§11 重大事件披露	
	11.1 基金份额持有人大会决议	
	本报告期内无基金份额持有人大会决议。	
	11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	
	本报告期内，基金管理人增聘沈光先生为公司副总经理，公司于2012年5月19日公告了上述事项。	
	本报告期内，2012年11月11日，经中国建设银行研究决定，聘任郑新丰为中国建设银行投资托管业务部总经理，其任职资格已经中国证监会核准批准 证监许可 2012(961)号。聘任郑新平为中国建设银行投资托管业务部副总经理，其任职资	

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 本报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况				金额单位：人民币元	
基金名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金	备注
		占当期	占当期	占当期	

昆仑证券	1	70,753,883.27	7.95%	57,488.57	7.60%	-
广发证券	1	46,459,919.65	5.22%	38,540.85	5.08%	-
国泰君安	1	46,450,179.03	5.22%	38,785.16	5.13%	-
申银万国	1	46,307,733.10	5.21%	39,541.50	5.23%	-
华创证券	1	39,467,121.90	4.44%	34,132.51	4.51%	-
光大证券	1	30,188,496.72	3.39%	25,660.07	3.39%	-
银河证券	1	29,962,448.36	3.37%	25,468.08	3.37%	-

中信万通	1	1,054,000.00	0.12%	895.90	0.12%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

安信证券	2	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

注：1. 专用交易单元的选择标准 4) 实力雄厚，信誉良好；
2) 财务状况良好，经营行为规范；
3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
5) 研究实力较强，能及时、定期、全面地为本基金提供研究服务；
6) 研究份额较有优势，能提供与基金来源的份额相匹配的研究服务。

	文旭耀的比例	比例	总额的比例
中信证券	--	--	--
中信证券(浙江)	--	--	--
华鑫证券	--	2,606,000,000.00	79.43%
鑫元证券	--	--	--
广发证券	--	--	--
国泰君安	--	--	--
申银万国	--	--	--

	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	155,000,000.00	4.72%	-
申联证券	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-
兴业证券	612,220.00	100.00%	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-
德盛证券	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-

二〇一三年三月二十九日